

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

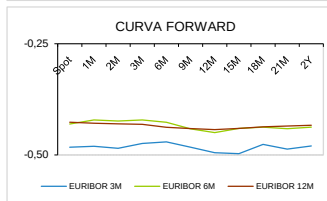
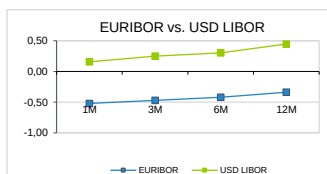
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

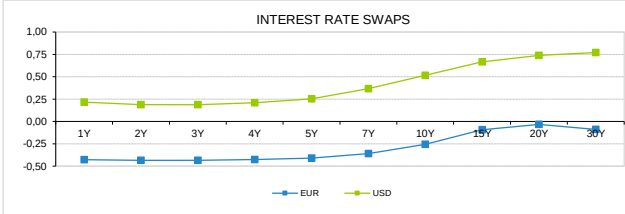
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5210	-1	-2	1M	0,1570	0	-1	0,0599	-0,7874
3M	-0,4720	0	-4	3M	0,2490	0	-3	0,0791	-0,7050
6M	-0,4210	0	-11	6M	0,3035	0	-6	0,1513	-0,6554
12M	-0,3380	0	-10	12M	0,4468	0	-6	0,2973	-0,5262

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4271	0	-7	-0,4430	-0,4048	-0,2762
2Y	-0,4349	-1	-5	-0,4382	-0,3781	-0,2363
3Y	-0,4345	-1	-5	-0,4281	-0,3438	-0,1942
4Y	-0,4262	-1	-5	-0,4090	-0,3061	-0,1521
5Y	-0,4103	-1	-6	-0,3818	-0,2665	-0,1040
7Y	-0,3593	-2	-8	-0,3154	-0,1823	-0,0260
10Y	-0,2558	-2	-9	-0,2005	-0,0680	0,0595
15Y	-0,0936	-3	-11	-0,0572	0,0200	0,0875
20Y	-0,0336	-3	-13	-0,0200	0,0123	0,0356
30Y	-0,0897	-4	-16	-0,0903	-0,0838	-0,0813

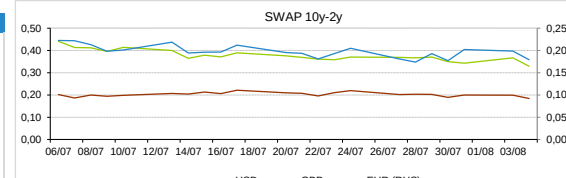
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2167	0	-4	0,1607	0,2779	0,5800
2Y	0,1875	0	-4	0,1700	0,3510	0,6510
3Y	0,1872	0	-5	0,2071	0,4175	0,6895
4Y	0,2094	-1	-7	0,2601	0,5047	0,7420
5Y	0,2524	-2	-9	0,3236	0,5500	0,7879
7Y	0,3673	-3	-12	0,4480	0,6395	0,8418
10Y	0,5165	-4	-15	0,5850	0,7547	0,8550
15Y	0,6668	-4	-17	0,6970	0,8030	0,8835
20Y	0,7392	-4	-18	0,7525	0,8220	0,8994
30Y	0,7709	-4	-19	0,7800	0,8093	0,8379

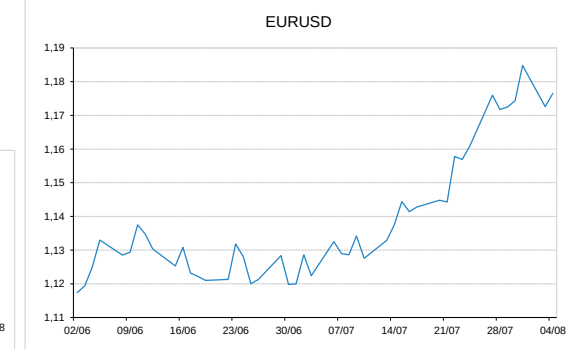
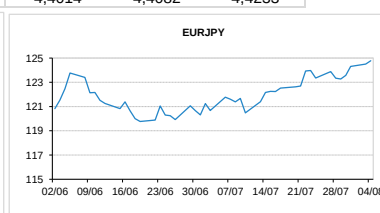
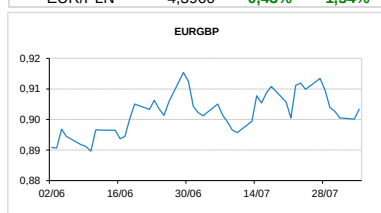


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,42	0,27	1,51	OT 2Y	-0,462	-0,02	1,30
JETFUEL	348,42	8,29	3,88	OT 5Y	-0,215	-0,03	-12,40
DIESEL	371,92	5,54	1,93	OT 10Y	0,300	-0,05	-13,10
COBRE	6.478,00	77,00	473,00	BUND 10Y	-1,251	-2,98	-11,60
ZINCO	2.316,00	4,50	295,50	SCHATZ 2Y	-0,066	-0,92	-1,60
OURO	1.995,15	24,41	220,17	T-NOTE 10Y	1,626	-2,51	-10,10
TRIGO	511,50	-9,50	19,50	T-NOTE 2Y	0,713	-0,37	-3,90
LICENÇA C02	26,78	0,65	-1,13	GILT 10Y	0,108	-1,76	-10,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1765	0,33%	3,89%	1,1787	1,1813	1,1855
EUR/GBP	0,90335	-0,36%	0,19%	0,9047	0,9061	0,9089
EUR/JPY	124,78	-0,22%	-2,40%	124,78	124,78	124,78
EUR/CHF	1,0774	0,25%	1,20%	1,0767	1,0758	1,0745
EUR/BRL	6,2766	-0,26%	-3,51%	6,3018	6,3294	6,3990
EUR/PLN	4,3960	0,43%	1,54%	4,4014	4,4082	4,4233



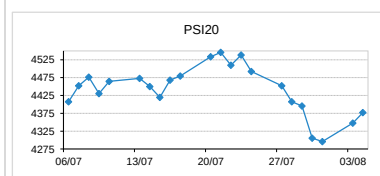
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1765	0,9034	124,78	1,0774	10,2908	7,4494	1,5715	1,64489	6,2766	10,7252
USD	0,8507	-	0,7665	105,925	0,9161	8,7525	6,3370	1,3371	1,3991	5,3180	9,1211

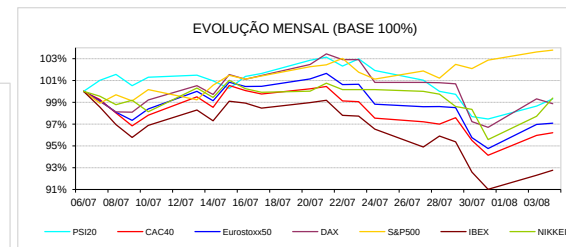
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,312	0,37	-24,08
BCP	0,102	1,91	-49,90
CORT. AMORIM	10,080	2,34	-10,80
CTT	2,495	6,40	-21,79
EDP	4,378	0,55	15,93
EDP R	13,800	-1,00	31,43
GALP	9,246	1,34	-37,95
IBERSOL	5,320	-0,75	-33,50
J MARTINS	14,310	0,18	-2,42
MOTA ENGIL	1,224	2,00	-34,55
NAVIGATOR	2,178	0,28	-36,84
NOS	3,768	-0,11	-21,50
PHAROL	0,115	-1,87	15,66
RAMADA	3,200	0,00	-45,21
REN	2,450	0,00	-9,93
SEMAPA	7,890	0,25	-42,49
SONAE CAP.	0,658	0,30	-12,62
SONAE SGPS	0,604	1,94	-33,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	6,40
CORT. AMORIM	2,34
MOTA ENGIL	2,00
SONAE SGPS	1,94
BCP	1,91
NOS	-0,11
IBERSOL	-0,75
EDP R	-1,00
PHAROL	-1,87



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.377,30	0,68%	-16,05%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.888,73	0,26%	-18,22%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.252,25	0,12%	-13,16%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.589,01	-0,46%	-4,98%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.300,39	0,17%	2,15%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.009,90	0,50%	-26,59%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.573,66	1,70%	-4,58%	24.115,95	16.358,19



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.